

Analisis Portofolio Optimum Saham Indeks LQ45 dan Deposito di Instrumen Investasi Indonesia Tahun 2013-2015

AGUNG PRAYITNO

(Pembimbing : Dr. Ir Dwi Eko Waluyo, MM)

Manajemen - S1, FEB, Universitas Dian Nuswantoro

www.dinus.ac.id

Email : 211201303039@mhs.dinus.ac.id

ABSTRAK

Investasi menjadi hal yang perlu diperhatikan bagi para investor untuk menyimpan dananya dan dapat memperoleh tingkat keuntungan dari suatu investasi tersebut, dalam melakukan investasi seorang investor harus memperhatikan dua hal yaitu risk dan return serta mempunyai ilmu yang cukup tentang instrumen investasi. Dengan melakukan investasi antara instrumen diharapkan investor dapat meminimalkan risiko dan memaksimalkan keuntungan. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis portofolio investasi yang dapat memberikan hasil optimal antara instrumen investasi saham LQ 45 dan deposito, yang dimulai 1 Januari 2013 sampai dengan 31 Desember 2015. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapatnya portofolio yang optimal, hal ini dikarenakan oleh korelasi antara kedua instrumen investasi saham LQ 45 dan deposito sebesar 5,275155%, sehingga mengakibatkan tidak terbentuknya titik-titik portofolio yang optimal. Investor yang memportofoliokan dananya antara instrumen investasi saham LQ 45 dan deposito tidak membentuk kombinasi portofolio yang optimal, sehingga investor hanya memilih salah satu instrumen investasi untuk menempatkan dana investasi.

Kata Kunci : Investasi, Portofolio Optimal, Risk dan Return

The Analysis of Optimum Portfolio of LQ45 and Deposit in Indonesian Investment Instrument During The Period 2013-2015.

AGUNG PRAYITNO

(Lecturer : Dr. Ir Dwi Eko Waluyo, MM)

*Bachelor of Management - S1, Faculty of Economy &
Business, DINUS University*

www.dinus.ac.id

Email : 211201303039@mhs.dinus.ac.id

ABSTRACT

Investment become a thing that need to be considered for investors to keep their funds and get the return from an investment, when doing investment an investor should be pay attention into two things, risk and return, and also have enough knowledge about investment. By doing investment between two instrument, the investors are expected to get the minimum risk and maximize the return. The aim of this research is to analyze the investment portfolio that could give the optimum result between LQ 45 investment instrument and deposit, which is started from January 1st 2013 until December 31st 2015. The result of this research shows that there are no optimum portfolio, it is because both of the investment instrument that are LQ-45 and deposit had a correlation, as much as 5,275155%, so the optimum portfolio can not be formed. Investor whom invest their funds into the stock of LQ-45 investment instrument and deposit can not form the optimum combination of portfolio, so the investor only choose one of the investment instrument for placing their fund.

Keyword : Investment, Optimal Portfolio, Risk and Return